山西证券超短债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要(2019年第2号)

基金管理人:山西证券股份有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会[2018]年[11]月[1]日证监许可[2018]1773号《关于准予山西证券超短债债券型证券投资基金注册的批复》注册募集。本基金的基金合同于2019年1月21日正式生效。

基金管理人保证《山西证券超短债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"本招募说明书")的内容真实、准确、完整。招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为债券型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,但低于股票型基金和混合型基金。本基金的投资范围包括中小企业私募债券,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年10月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

一、基金管理人概况
名称:山西证券股份有限公司
住所及办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
成立时间:1988年7月28日
法定代表人:侯巍
批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行复[1988]315号
组织形式:股份有限公司
存续期限:持续经营
注册资本:人民币28.2873亿元人民币
电话:(0351)8686966
传真:(0351)8686918
股权结构:

序号	股东名称	持股数量	持股比例
1	山西金融投资控股集团有限公司	865,314,455	30.59%
2	太原钢钒(集团)有限公司	282,605,635	9.99%
3	山西国际电力集团有限公司	199,268,856	7.04%
4	北京中吉金投资产管理有限公司－中吉金投－稳赢2号投资基金	45,446,000	1.61%
5	中央汇金资产管理有限责任公司	40,619,400	1.44%
6	郑州市热力总公司	26,401,342	0.93%
7	河南省安融房地产开发有限公司	25,840,351	0.91%
8	中国银河证券股份有限公司约定购回专用账户	21,080,000	0.75%
9	中国农业银行股份有限公司－交易型开放式指数证券投资基金	20,297,048	0.72%
10	山西省科技基金发展有限公司	17,000,000	0.60%

注:截止到2019.6.30前十大股东持股情况

经营范围:证券经纪;证券自营;证券资产管理;证券投资咨询;与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问;证券投资基金代销;为期货公司提供中间介绍业务;融资融券;代销金融产品;公开募集证券投资基金管理业务。

二、主要人员情况

1、董事会成员

侯巍先生,中共党员,硕士学位。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员、董事、总经理;2008年1月至2015年2月任公司董事、总经理;2008年4月至2010年9月任大华期货有限公司董事;2009年4月至今任中德证券有限责任公司董事长;2008年2月至2014年12月历任公司党委委员、党委副书记;2014年12月至今任公司党委书记;2015年2月至今任公司董事长、总经理;2016年12月至今任山西股权交易中心有限公司董事长。

杨增军先生,中共党员,本科学历,高级会计师,2009年3月至2015年5月,在晋商银行股份有限公司工作,历任财务总监、首席财务官;2015年5月至2016年7月,在山西国信投资集团有限公司工作,任财务总监兼计划财务部总经理、科技信息部总经理(兼)、投资决策委员会委员、财务审查委员会副主任;2016年7月至今在山西金融投资控股集团有限公司工作,任财务总监兼财务管理部总经理;2017年2月至今兼任山西省产权交易中心股份有限公司监事、监事会主席,山西省农业信贷融资担保有限公司监事;2018年2月至今任公司董事。

李华先生,中共党员、本科学历,会计师。1995年7月至2002年3月在太钢集团财务处成本科从事会计工作;2002年4月至2008年6月担任太钢集团计财部成本管理室科长;2008年7月至2011年9月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部副部长;2011年10月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司计财部部长;2016年4月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司财务总监;2016年11月至2017年7月担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事会秘书;2016年10月至今担任山西太钢不锈钢股份有限公司董事;2017年8月至2018年10月担任太原钢铁(集团)有限公司副总经理,兼任太原钢铁(集团)国际经济贸易有限公司、山西太钢投资有限公司、山西太钢能源有限公司、太钢进出口(香港)有限公司、太钢集团财务有限公司董事长、太钢(天津)融资租赁有限公司、太钢(天津)商业保理有限公司董事长、总经理,山西晋煤太钢能源有限责任公司、太钢集团临汾钢铁有限公司董事。2017年12月至2018年10月担任山西太钢保险代理有限公司董事长。2018年10月至今任太原钢铁(集团)有限公司党委常委、董事;2018年11月至今担任山西太钢不锈钢股份有限公司副董事长、总经理,兼任山西太钢不锈钢精密带钢有限公司、天津太钢天管不锈钢有限公司、山西太钢不锈钢钢管有限公司董事长。2018年8月至今任公司董事。

夏贵所先生,中共党员、本科学历。1996年11月至1998年1月任山西通宝能源股份有限公司财务部副经理,1998年1月至2000年8月任山西通宝能源股份有限公司总经理助理、财务部经理,2001年11月至2004年3月任山西通宝能源股份有限公司总会计师,2004年3月至2008年2月任山西通宝能源股份有限公司副总经理兼会计师,2008年2月至2010年7月任山西国际电力配电管理公司总会计师、党委委员,2010年7月至今任山西国际电力集团有限公司财务部经理(期间:2014年2月至2017年3月任晋能电力集团有限公司总会计师、党委委员职务),2016年5月至今任山西通宝能源股份有限公司董事;2017年5月至今任山西国际电力集团有限公司董事;2010年6月至今任山西国电置业有限公司董事;2010年8月至今任山西地方电力有限公司董事;2011年2月至今任山西国际电力资产管理有限公司董事;2014年3月至今任晋能环保工程有限公司董事;2015年4月至今任山西国际电力投资有限公司董事;2017年11月至今任晋能集团有限公司财务管理部副部长);2018年5月至今任晋商银行股份有限公司、山西灏鼎能源投资有限公司、朝晖产业投资基金管理有限公司监事;2018年8月至今任公司董事。

朱海武先生,硕士学位,中国注册会计师、高级会计师、中国注册税务师、澳洲资深会计师。2000年1月至今,在瑞华会计师事务所工作,担任合伙人。2014年10月至今,任华远地产股份有限公司独立董事;2015年5月至今任公司独立董事。

容和平先生,中共党员,本科学历。2001年6月至2010年6月任山西大学商务学院副院长、教授;2011年5月至今任山西工商学院副院长、教授;2013年6月至今任太原化工股份有限公司独立董事;2011年5月至今任公司独立董事。

王卫国先生,中共党员,硕士学位。1994年4月起任中国政法大学教授(2016年5月退休);2008年9月至今兼职中国银行法学研究会,现任会长;2014年10月至今任藏格控股股份有限公司独立董事;2016年11月至今任陕西宝光真空电器股份有限公司董事;2011年5月至今任公司独立董事。

�祥先生,中共党员,硕士学位。2005年12月至2009年3月任浙江大学经济学院金融系教授、博士生导师、系主任、院长助理;2009年4月至2013年7月,任浙江大学经济学院党委书记、副院长;2009年4月至今任浙江大学经济学院教授、博士生导师;2014年7月至今任国信证券股份有限公司独立董事;2015年8月至今任英洛华科技股份有限公司独立董事;2016年7月至今任荣安地产股份有限公司独立董事;2011年5月至今任公司独立董事。

王怡里先生,中共党员,学士学位。2008年2月至2013年3月任山西证券董事会办公室总经理;2008年2月至2016年5月任山西证券综合管理部总经理;2010年2月至今担任山西证券党委委员;2010年4月至今任山西证券董事会秘书;2011年8月至今任山西证券副总经理;2013年6月至今任山西中小企业创业投资基金(有限合伙)执行事务合伙人委派代表、山证基金管理有限公司董事长;2014年6月至今任山证资本管理(北京)有限公司董事长;2014年10月至今任龙华启富(深圳)股权投资基金管理有限公司董事长、北京山证并购资本投资合伙企业执行事务合伙人委派代表;2015年2月至今任山证投资有限责任公司董事长;2016年11月至今担任中德证券有限责任公司董事;2018年1月至今任汾西启富扶贫引导基金合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表;2018年7月至今任山西国投创新绿色能源股权投资合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表;2018年8月至今任山西交通产业基金合伙企业(有限合伙)执行事务合伙人委派代表;2018年12月至今任山证创新投资有限公司执行董事、总经理;2018年3月至今任公司职工董事。

2、监事会成员

焦杨先生,中共党员,本科学历,硕士学位。2010年2月至2014年12月任山西信托股份有限公司常务副总经理;2014年12月至2016年6月任山西国信投资集团有限公司风控总监兼审计风控部总经理;2016年6月至今任山西金融投资控股集团有限公司运营总监;2016年6月至2018年2月任山西金融投资控股集团有限公司资本运营部总经理;2018年2月至今任山西金融投资控股集团有限公司投资管理部总经理;2015年1月至今任汇丰晋信基金管理有限公司监事会主席、山西投权交易中心有限公司监事;2016年12月至今,任山西投权交易中心有限公司监事会主席;2010年10月至今任公司监事;2011年5月至今任公司监事会主席。

郭志宏先生,中共党员,本科学历,EMBA高级工商管理硕士学位,高级经济师。2012年5月至2015年3月,任山西信托股份有限公司监事、监事会主席;2015年3月至2017年1月任山西信托股份有限公司党委委员、副总裁;2017年1月至2019年1月任山西省融资再担保有限公司党委书记、董事长;2019年1月至今任山西省融资再担保集团有限公司(原山西省融资再担保有限公司)党委书记、董事长;2015年5月至今任公司监事。

王国峰先生,中共党员,本科学历。2005年3月至2015年3月,任长治市行政事业单位国有资产管理中心副主任;2015年9月至2017年10月,任长治市行政事业单位国有资产管理中心主任;2017年10月至今,任长治市经济建设投资服务中心主任;2015年5月至今任公司监事。

高明先生,中共党员,大专学历。1984年9月至今历任汾酒集团有限责任公司基建出纳、会计、财务科副科长、科长、审计部副主任、主任、山西杏花村汾酒厂股份有限公司财务处处长、汾酒集团有限责任公司财务部主任、副总会计师;2013年8月至今任山西杏花村汾酒集团有限责任公司总会计师;2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司董事;2008年1月至今任公司监事。

关峰先生,中共党员,本科学历。2001年6月至2013年6月,历任山西焦化集团有限公司审计处副处长、处长;2013年6月至2014年4月,任山西焦化集团有限公司财务处处长;2014年5月至2017年5月,任山西焦化集团有限公司集团副总会计师兼财务处处长;2017年2月至今任山西焦煤集团飞虹化工股份有限公司总经理助理、财务部部长;2015年5月至今任公司监事。

罗爱民先生,中共党员,本科学历。2005年3月至2010年3月任山西省经贸资产经营有限责任公司处长;2010年3月至2017年5月任山西经贸集团技改投资有限公司总经理;2017年5月至今任山西经贸集团技改投资有限公司执行董事;2018年12月至今任山西旅游集团资产管理有限公司董事长、山西经贸集团煤焦投资有限公司董事长;2007年6月至今,任太原重工股份有限公司监事;2011年5月至今任公司监事。

李国林先生,中共党员,本科学历,学士学位。2012年4月至2016年5月任山西省科技基金发展总公司副总经理;2016年5月至2016年8月,任山西省科技基金发展总公司常务副总经理;2016年8月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司总经理;2016年9月至2017年12月任山西省科技基金发展总公司党支部书记。2017年12月至今任山西省科技基金发展有限公司(原山西省科技基金发展总公司)党支部书记、执行董事、总经理。2014年9月至今任山西久晖股权投资管理有限公司执行董事;2014年6月至今任山西澳坤生物农业股份有限公司董事;2014年4月至今任太原风华信息装备股份有限公司董事;2015年5月至2017年7月任山西中电科新能源技术有限公司董事;2012年3月至今任晋城市富基新材料股份有限公司董事;2014年12月至今任山西诺亚信创业投资有限公司董事;2012年12月至今任运城市奥新纳米新技术有限公司董事;2015年1月至今任山西青山化工有限公司董事;2018年3月至今任山西康宝生物制品股份有限公司董事;2015年5月至今任公司监事。

刘奇旺先生,中共党员,本科学历。1992年10月至2017年12月,历任吕梁市国有资产投资集团公司(原吕梁地区信托投资公司)办公室副主任、办公室主任、总会计师;2017年12月至今任吕梁国投集团有限公司(原吕梁市国有资产投资集团公司)总会计师;2015年5月至今任公司监事。

胡朝晖先生,中共党员,学士学位。2008年1月至今任公司职工监事;2008年2月至2016年5月任公司风险控制部总经理;2016年5月至今公司稽核考核部总经理;2009年1月起任公司监事会副主席。2011年7月至今任山证投资有限责任公司监事;2014年6月任山证资本管理(北京)有限公司监事。

翟太煌先生,中共党员,硕士学位。2008年1月至今任公司职工监事;2008年1月至2019年3月任公司研究所所长;2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事;2014年6月任山证资本管理(北京)有限公司董事;2019年3月至今任公司研究所总监。

允济敏女士,中共党员,硕士学位。2006年4月至2016年5月任公司人力资源部总经理;2006年4月至2011年8月,任公司党委办公室主任;2008年1月至今任公司职工监事;2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事;2013年6月至今任山证基金管理有限公司董事;2014年6月至今任山证资本管理(北京)有限公司董事;2016年6月至今任山证投资有限责任公司专职副董事长。

闫晓华女士,中共党员,学士学位。2006年7月至2008年1月任公司稽核考核部总经理,2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工监事;2008年1月至今任公司职工监事;2008年2月至2016年5月任公司稽核考核部总经理;2016年5月至2017年7月任公司合规管理部总经理;2017年2月至今任公司总裁助理。

3、公司高级管理人员

侯巍先生,请参见本节"董事会成员"。

孟有军先生,中共党员,本科学历。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司党委委员;2007年8月至2008年1月任山西证券有限责任公司副总经理;2008年1月至今任公司党委委员、副总经理;2008年11月至2015年2月任公司合规总监;2017年1月至今,任格林大华期货有限公司董事长。

乔俊峰先生,中共党员,硕士学位。2007年4月至2008年1月任山西证券有限责任公司职工董事;2008年2月至2015年5月任公司职工董事;2008年10月至2010年9月任大华期货有限公司总经理;2010年9月至2013年9月任大华期货有限公司董事长;2010年2月至今担任公司党委委员。2010年12月至今任公司副总经理;2013年9月至2017年1月任格林大华期货有限公司董事长;2016年1月至今任山证国际金融控股有限公司董事长。2017年6月至今任公司上海资产管理分公司总经理。

汤建雄先生,学士学位。2008年2月至2013年3月任公司计划财务部总经理;2007年11月至2013年10月任大华期货有限公司董事;2009年4月至今担任中德证券有限责任公司董事;2010年4月至2015年12月任公司财务总监;2011年8月至今任公司副总经理;2011年7月至今任山证投资有限责任公司董事;2013年10月至今任格林大华期货有限公司董事;2015年2月至2016年1月代为履行合规总监职责,2016年1月至2017年6月任公司合规总监。2017年7月至今任公司首席风险官,2018年1月至今任公司财务负责人。

王怡里先生,请参见本节"董事会成员"。

高晓峰先生,中共党员,学士学位。1996年8月至1999年8月任职于山西省证券管理办公室证信证券培训中心;1999年8月至2010年3月先后任职于中国证监会山西监管局机构处、期货处和上市处;2010年3月至2014年8月先后任中国证监会山西监管局办公室副主任(主持工作)、主任;2014年8月至2015年11月任中国证监会山西监管局期货处处长;2015年11月至2017年3月任中国证监会山西监管局法制处处长(期间,2016年8月至2017年1月挂职山西金融投资控股集团有限公司投资管理部副总经理);2017年6月至今,任公司副总经理、合规总监。

4、基金经理

刘凌云女士,上海交通大学管理科学与工程专业硕士。2007年6月29日至2013年6月28日任光大证券股份有限公司固定收益总部债券交易员。2013年7月,在富国基金管理有限公司任高级交易员兼研究助理;2014年8月5日至2015年4月27日任富国富钱包货币市场基金基金经理;2014年8月5日至2015年4月27日任富国天时货币市场基金基金经理。2016年8月3日至2017年3月起担任中欧货币市场基金基金经理;2016年8月3日至2017年3月担任中欧滚钱宝发起式货币市场基金基金经理;2016年12月至2017年3月担任中欧骏泰货币市场基金基金经理。2017年4月加入山西证券股份有限公司资管固收部担任投资主办;2018年7月转入山西证券公募基金部;2019年1月起担任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理;2019年6月起担任山西证券裕睿6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。刘凌云女士具备基金从业资格。

华志贵先生,复旦大学经济学硕士。2004年5月至2008年8月,在东方证券股份有限公司固定收益业务总部任高级投资经理;2008年9月至2009年8月,在中欧基金管理有限公司,从事研究、投资工作;2009年9月,加入华宝兴业基金管理有限公司,2010年6月至2011年9月担任华宝兴业现金宝货币市场基金基金经理,2010年6月至2013年4月担任华宝兴业增强收益债券型投资基金基金经理,2011年4月至2014年5月担任华宝兴业可转债基金基金经理。2014年11月加盟本公司公募基金部、2015年5月起任山西证券日日添利货币市场基金基金经理,2016年5月至2018年5月担任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理,2016年8月至2018年8月担任山西证券裕利债券型证券投资基金基金经理,2018年8月起担任山西证券裕利定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2019年1月起担任山西证券超短债债券型证券投资基金基金经理;2019年5月起担任山西证券裕泰3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。华志贵先生具备基金从业资格。

5、投资决策委员会成员

主任委员:
乔俊峰,公司副总裁
委员:
薛永红,公募基金部总经理;
华志贵,基金经理;
娄伶俐,研究员;
刘凌云,基金经理;
郭熠,私人财富部副总经理;
石晋,研究所研究员。
上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金注册或备案手续;

3、自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7、依法接受基金托管人的监督;

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度、半年度和年度基金报告;

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露,因审计、法律等向外部专业顾问提供的情况除外;

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

23、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

四、基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2)不公平地对待管理的不同基金财产;

(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)侵占、挪用基金财产;

(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)依照法律、行政法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、违反规定向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

5、向其基金管理人、基金托管人出资;

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合本基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行,无需经基金份额持有人大会审议。

六、基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

七、基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、内部控制原则

(1)全面性原则:公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;

(2)独立性原则:公司设立独立的监察稽核部门,监察稽核部门保持高度的独立性和权威性,负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查;

(3)相互制约原则:公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系;

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性;

(5)重要性原则:公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上,内部风险控制与公司业务发展同等重要。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构,由最高管理层对风险管理负最终责任,各个业务部门负责本部门的风险评估和监控,监察稽核部门负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言,包括如下组成部分:

(1)董事会

负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理,从而控制公司的整体运营风险。

(2)合规总监

独立行使督察权利,直接对董事会负责,及时向审计与风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告。

(3)首席风险官

负责组织、协调、落实全面风险管理工作。

(4)风险管理执行委员会

根据公司总体风险控制目标,将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门;讨论、协调各部门之间的风险管理过程;听取各部门风险管理工作方面的汇报,确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点,并调整与改进相关的风险处理和控制策略;讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。

(5)投资决策委员会

负责指导基金部的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略。

(6)合规管理部:负责对公募基金管理业务相关制度、合同和流程进行合规性审核;按照监管机构的要求和公司的规定定期、不定期地进行合规检查,组织落实公募基金管理业务的业务隔离和反洗钱工作;负责处理公募基金管理业务相关法律诉讼事务;

(7)风险管理部:负责对整体业务进行全程监控,拟定和完善公募基金管理业务风险管理制度和风险控制流程;建立和完善公募基金管理业务风险监控指标体系;监控和检查公募基金管理业务运行情况;分析、评估公募基金管理业务的风险状况,并向公司总经理办公会及相关部门提交风险评估报告;

(8)稽核审计部:负责对公募基金管理业务进行全面的审计与监察、稽核,检查各部门对公募基金管理业务相关制度的执行情况,并出具监察稽核报告;

(9)业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。各部门的部门经理对本部门的风险负全部责任,负责履行公司的风险管理程序,负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护,用于识别、监控和降低风险。

3、内部控制制度综述

(1)风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格;不断提高经营管理水平,在风险最小化的前提下,确保基金份额持有人利益最大化;建立行之有效的风险控制机制和制度,确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整;维护公司信誉,保持公司的良好形象。针对公司面临的各种风险,包括政策和市场风险,管理风险和职业道德风险,分别制定严格防范措施,并制定岗位分离制度、空间分离制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

(2)监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设合规总监、合规管理部和稽核审计部。合规总监全面负责公司的监察稽核工作,可在授权范围内列席任何会议,调阅公司任何档案材料,对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核,出具监察稽核报告,报公司董事会和中国证监会。如发现公司有重大违规行为,应立即向公司董事会和中国证监会报告。合规管理部、稽核审计部具体执行合规管理与稽核审计工作,并协助合规总监工作。合规管理部、稽核审计部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见,并提交风险管理执行委员会;检查公司各部门执行内部管理制度的情况;监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性;监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性;调查公司内部的违规事件;协助监管机关调查处理相关事项;负责员工的离任审计;协调外部审计事宜等。

(3)内部会计控制制度

建立了基金会计的工作制度及相应的操作控制规程,确保会计业务有章可循;按照相互制约原则,建立了基金会计业务的复核制度以及与托管行相关业务的相互核查监督机制;为了防范基金会计在资金头寸管理上出现透支风险,制定了资金头寸管理制度;为了确保基金资产的安全,公司严格规范基金清算交割工作,并在授权范围内,及时准确地完成基金清算;强化会计的事前、事中、事后监督和考核制度;为了防止会计数据的毁损、散失和泄密,制定了完善的档案保管和财务交接制度。

4、风险管理和内部风险控制的措施

(1)建立、健全内控体系,完善内控制度。公司建立、健全了内控结构,高管人员关于内控有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保监察稽核工作是独立的,并得到高管人员的支持,同时置备操作手册,并定期更新;

(2)建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全了各项制度,做到基金经理分开、投资决策分开、基金交易集中,形成不同部门、不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防范风险;

(3)建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险;

(4)建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了风险管理执行委员会,使用适合的程序,确认和评估与公司运作有关的风险;公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度做出决策;

(5)建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统,如电脑预警系统、投资监控系统,能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控;

(6)使用数量化的风险管理手段。采取数量化、技术化的风险控制手段,建立数量化的风险管理模型,用以提示市场趋势、行业及个股的风险,以便公司及时采取有效的措施,对风险进行分散、控制和规避,尽可能地减少损失;

(7)提供足够的培训。公司制定了完整的培训计划,为所有员工提供足够和适当的培训,使员工明确其职责所在,控制风险。

5、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

(一)基金托管人概况
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
住　　所:中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址:中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码:200336
注册时间:1987年3月30日
注册资本:742.63亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:陆志俊
电　话:95559

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业,成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行,总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市,2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2019年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告,交通银行一级资本位列第11位,连续五年跻身全球银行20强;根据2019年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜,交通银行营业收入位列第150位,较上年提升18位。

截至2019年6月30日,交通银行资产总额为人民币98,866.08亿元。2019年1-6月,交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币427.49亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心(下文简称"托管中心")。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

任德奇先生,副董事长、执行董事、行长,高级经济师。

任先生2018年8月起任本行副董事长、执行董事、行长;2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长,其中:2015年10月至2018年6月兼任中银香港(控股)有限公司非执行董事,2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁;2014年7月至2016年11月任中国银行副行长,2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理;1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行,中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士,资产托管业务中心总裁,高级经济师。

袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁;2007年12月至2015年8月,历任本行资产托管部总经理助理、副总经理,本行资产托管业务中心副总裁;1999年12月至2007年12月,历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长,会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系,获得学士学位,2005年于新疆财经学院获硕士学位。

(三)基金托管业务经营情况

截至2019年6月30日,交通银行托管证券投资基金411只。此外,交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、ODIE资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产和QDLP资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定,加强内部管理,托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章,通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释,有效地实现对各项业务的风险管控,确保业务稳健运行,保护基金持有人的合法权益。

(二)内部控制原则

1、合法性原则:托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则:托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制,覆盖各项业务、各个部门和各级人员,并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节,建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则:托管中心独立负责受托基金资产的保管,保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立,对不同的受托基金资产分别设置账户,独立核算,分账管理。

4、制衡性原则:托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则,从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约,并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则:托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上,形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制,通过行之有效的控制流程、控制措施,建立合理的内控程序,保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则:托管中心内控控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应,尽量降低经营运作成本,以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

(三)内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产